

香港交易及結算所有限公司、香港聯合交易所有限公司及香港中央結算有限公司對本公告之內容概不負責，對其準確性或完整性亦不發表任何聲明，並明確表示概不就因本公告全部或任何部分內容而產生或因倚賴該等內容而引致的任何損失承擔任何責任。



(於中華人民共和國註冊成立的股份有限公司，
中文公司名稱為华泰證券股份有限公司，在香港以HTSC名義開展業務)
(股份代號：6886)

海外監管公告

本公告乃根據上市規則第13.10B條規則作出。

茲載列本公司在上海證券交易所網站刊登之《华泰證券股份有限公司2015年第三期次級債券債券受託管理人報告》，僅供參閱。

釋義

於本公告，除文義另有所指外，下列詞彙具有以下涵義。

「本公司」 指 於中華人民共和國以华泰證券股份有限公司的公司名稱註冊成立的股份有限公司，於2007年12月7日由前身华泰證券有限責任公司改制而成，在香港以「HTSC」名義開展業務，根據公司條例第16部以中文獲准名稱「華泰六八八六股份有限公司」及英文公司名稱「Huatai Securities Co., Ltd.」註冊為註冊非香港公司，其H股於2015年6月1日在香港聯合交易所有限公司主板上市(股票代碼：6886)，其A股於2010年2月26日在上海證券交易所上市(股票代碼：601688)

承本公司董事會命
董事長
周易

中國江蘇，2017年6月22日

於本公告日期，董事會成員包括執行董事周易先生；非執行董事浦寶英女士、高旭先生、陳寧先生、許峰先生、徐清先生及周勇先生；以及獨立非執行董事陳傳明先生、劉紅忠先生、李志明先生、楊雄勝先生及劉艷女士。

股票简称：华泰证券
债券简称：15 华泰 04

股票代码：601688
债券代码：125978.SH

华泰证券股份有限公司 2015 年第三期次级债券 债券受托管理人报告 (2016 年度)

发行人

华泰证券股份有限公司



(江苏省南京市江东中路 228 号)

债券受托管理人

中信证券股份有限公司



(广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座)

2017 年 6 月

声明

中信证券股份有限公司（“中信证券”）编制本报告的内容及信息均来源于发行人对外公布的《华泰证券股份有限公司 2016 年年度报告》全文等相关公开信息披露文件、华泰证券股份有限公司（以下简称“华泰证券”、“发行人”或“公司”）提供的证明文件以及第三方中介机构出具的专业意见。

本报告不构成对投资者进行或不进行某项行为的推荐意见，投资者应对相关事宜做出独立判断，而不应将本报告中的任何内容据以作为中信证券所作的承诺或声明。在任何情况下，投资者依据本报告所进行的任何作为或不作为，中信证券不承担任何责任。

目录

| | | |
|-----|----------------------------|----|
| 第一章 | 本期债券概况 | 4 |
| 第二章 | 发行人 2016 年度经营及财务状况 | 6 |
| 第三章 | 发行人募集资金使用情况 | 11 |
| 第四章 | 本期债券利息偿付情况 | 12 |
| 第五章 | 债券持有人会议召开情况 | 13 |
| 第六章 | 债券跟踪评级情况 | 14 |
| 第七章 | 负责处理与本期债券相关事务专人的变动情况 | 15 |
| 第八章 | 其他事项 | 16 |

第一章 本期债券概况

一、发行人名称

中文名称：华泰证券股份有限公司

英文名称：Huatai Securities Co., Ltd.

二、核准文件和核准规模

发行人于 2014 年 11 月 25 日召开第三届董事会第十三次会议，经与会董事审议，一致通过了《关于公司发行次级债券的议案》，并同意提交公司股东大会审议。

2014 年 12 月 11 日，发行人召开 2014 年第四次临时股东大会，审议通过了《关于公司发行次级债券的议案》。

经上海证券交易所上市预审核通过，发行人获准非公开发行不超过 200 亿元的次级债券。本次发行为上述 200 亿元的首期，发行规模为 180 亿元，债券名称为华泰证券股份有限公司 2015 年第三期次级债券。

根据监管要求，公司本期次级债券将在发行完毕后按证券监管部门要求进行备案。

三、本期债券的主要条款

1、债券名称：华泰证券股份有限公司 2015 年第三期次级债券

2、债券简称：15 华泰 04

3、债券代码：125978.SH

3、债券期限：本期债券期限为 2 年期。

4、发行总额：人民币 180 亿元。

5、债券利率或其确定方式：本期债券为固定利率债券，票面利率为 5.5%。

6、债券起息日：2015 年 6 月 26 日。

7、债券付息日：2016 年至 2017 年每年的 6 月 26 日为上一个计息年度的付息日。如遇法定节假日或休息日，则顺延至其后的第 1 个工作日；每次付息款项不另计利息。

8、债券到期日：本期债券的到期日为 2017 年 6 月 26 日。

9、债券兑付日：本期债券的兑付日期为 2017 年 6 月 26 日。如遇法定节假日或休息日，则顺延至其后的第 1 个工作日；顺延期间兑付款项不另计利息。

10、计息期限：本期债券的计息期限为 2015 年 6 月 26 日至 2017 年 6 月 26 日。

11、还本付息方式：采用单利按年计息，不计复利。每年付息一次，到期一次还本，最后一期利息随本金的兑付一起支付。年度付息款项自付息日起不另计利息，本金自本金兑付日起不另计利息。

12、支付金额：本期债券于每年的付息日向投资者支付的利息金额为投资者截至付息登记日收市时所持有的本期债券票面总额与对应的票面年利率的乘积；于兑付日向投资者支付的本息金额为投资者截至兑付登记日收市时所持有的本期债券最后一期利息及所持有的债券票面总额的本金。

13、担保情况：本期债券无担保。

14、信用级别及资信评级机构：经上海新世纪资信评估投资服务有限公司综合评定，发行人的主体信用等级为 AAA，本期债券的信用等级为 AA+。

15、登记机构：中国证券登记结算有限责任公司。

第二章 发行人 2016 年度经营及财务状况

一、发行人经营情况

发行人的经营范围为：证券经纪业务；证券自营；证券承销业务（限承销国债、非金融企业债务融资工具、金融债（含政策性金融债））；证券投资咨询；为期货公司提供中间介绍业务；融资融券业务；代销金融产品业务；证券投资基金代销；证券投资基金托管；黄金等贵金属现货合约代理和黄金现货合约自营业务；股票期权做市业务；中国证监会批准的其他业务。

截至 2016 年 12 月 31 日，公司拥有证券营业部 242 家，旗下控股华泰联合证券有限责任公司、华泰期货有限公司、江苏股权交易中心有限责任公司；全资设立华泰金融控股（香港）有限公司、华泰紫金投资有限责任公司、华泰创新投资有限公司、华泰证券（上海）资产管理有限公司；参股南方基金管理有限公司、华泰柏瑞基金管理有限公司，已基本形成集证券、基金、期货、直接投资和海外业务等为一体的、国际化的证券控股集团架构，综合实力和盈利能力居全国券商前列。

公司主营业务主要分为经纪及财富管理业务、投资银行业务、资产管理业务、投资及交易业务、海外业务。2016 年，公司各主要业务收入及成本占比情况如下：

单位：人民币万元

| 业务类别 | 营业收入 | | 营业成本 | |
|-----------|---------------------|---------------|-------------------|---------------|
| | 金额 | 占比（%） | 金额 | 占比（%） |
| 经纪及财富管理业务 | 1,019,762.99 | 60.28 | 467,914.53 | 54.93 |
| 投资银行业务 | 239,837.85 | 14.18 | 148,631.85 | 17.45 |
| 资产管理业务 | 279,440.88 | 16.52 | 74,442.40 | 8.74 |
| 投资与交易业务 | 170,768.06 | 10.09 | 27,201.01 | 3.19 |
| 海外业务及其他 | -18,107.84 | -1.07 | 133,717.06 | 15.70 |
| 合计 | 1,691,701.94 | 100.00 | 851,906.86 | 100.00 |

2016 年，公司各主要业务毛利情况如下：

单位：人民币万元

| 业务类别 | 毛利 | | 毛利率（%） |
|-----------|-------------------|---------------|--------------|
| | 金额 | 占比（%） | |
| 经纪及财富管理业务 | 551,848.46 | 65.71 | 54.12 |
| 投资银行业务 | 91,206.00 | 10.86 | 38.03 |
| 资产管理业务 | 204,998.48 | 24.41 | 73.36 |
| 投资与交易业务 | 143,567.05 | 17.10 | 84.07 |
| 海外业务及其他 | -151,824.90 | -18.08 | -838.45 |
| 合计 | 839,795.09 | 100.00 | 49.64 |

1、经纪及财富管理业务

经纪及财富管理业务主要包括证券与期货经纪、金融产品销售、机构销售与研究、资本中介业务等。证券与期货经纪业务方面，公司主要代理客户买卖股票、基金、债券及期货，提供便捷交易服务。金融产品销售业务方面，公司主要向客户提供各种金融产品销售服务和资产配置服务，相关金融产品由公司及其他金融机构管理。机构销售与研究业务方面，公司向机构客户推广和销售证券产品及服务，并提供各种专业化研究服务，协助机构客户作出投资决策。资本中介业务方面，公司向客户提供融资融券、股票质押式回购等多样化融资服务。

经纪及财富管理业务主要业绩驱动因素包括手续费及佣金收入、利息收入等。2016 年，公司经纪及财富管理业务实现营业收入人民币 1,019,762.99 万元，同比减少 43.30%；营业成本人民币 467,914.53 万元，同比减少 20.15%；毛利率 54.12%，同比减少 13.30 个百分点。

2、投资银行业务

投资银行业务主要包括股权承销、债券承销、财务顾问、场外业务等。股权承销业务方面，公司为国内企业客户提供 IPO 及股权再融资服务。债券承销业务方面，公司为国内企业客户提供各类债券融资服务。财务顾问业务方面，公司从产业布局与策略角度为国内企业客户提供以并购为主的财务顾问服务。场外业务方面，公司作为主办券商提供推荐服务，帮助非上市公司于新三板挂牌并进行

股份转让，并为挂牌企业提供后续融资服务；公司出资设立的江苏股权交易中心为公司其他业务提供交叉销售机会并帮助公司为私募股权基金探索及发掘更多投资机会。

投资银行业务主要业绩驱动因素包括顾问费、承销及保荐费等。2016 年，公司投资银行业务实现营业收入人民币 239,837.85 万元，同比增长 29.18%；营业成本人民币 148,631.85 万元，同比增长 22.32%；毛利率 38.03%，同比增加 3.48 个百分点。

3、资产管理业务

资产管理业务主要包括证券公司资产管理、私募股权基金管理及基金公司资产管理业务等。证券公司资产管理业务方面，公司通过全资子公司华泰资管公司参与经营证券公司资产管理业务，包括集合资产管理业务、定向资产管理业务、专项资产管理业务与公募基金管理业务（含大集合）。私募股权基金管理业务方面，公司通过全资子公司华泰紫金投资开展直接投资业务，包括私募股权基金的投资与管理。基金公司资产管理业务方面，公司持有两家公募基金管理公司南方基金和华泰柏瑞的非控股权益，通过其参与经营基金公司资产管理业务。

资产管理业务主要业绩驱动因素包括管理费及业绩表现费、投资收益等。2016 年，公司资产管理业务实现营业收入人民币 279,440.88 万元，同比增长 29.03%；营业成本人民币 74,442.40 万元，同比增长 41.50%；毛利率 73.36%，同比减少 2.35 个百分点。

4、投资及交易业务

投资及交易业务主要包括权益证券投资及交易、固定收益投资及交易、OTC 金融产品与交易业务等。权益证券投资及交易业务方面，公司以自有资金开展股票、ETF 及衍生工具的投资与交易，并从事交易所买卖金融产品的做市服务等。固定收益投资及交易业务方面，公司在银行间债券市场及股票交易所开展各类固定收益类证券的交易业务及衍生工具的交易业务，并从事银行间债券市场的做市商业业务等。OTC 金融产品与交易业务方面，公司为客户提供及交易 OTC 金融产品，主要包括权益类收益互换、收益凭证与资产管理计划等，并从事新三板做市报价服务等。

投资及交易业务主要业绩驱动因素包括投资收益等。2016 年，公司投资及

交易业务实现营业收入人民币 170,768.06 万元，同比减少 53.15%；营业成本人民币 27,201.01 万元，同比减少 61.35%；毛利率 84.07%，同比增加 3.38 个百分点。

5、海外业务及其他

公司通过全资子公司华泰金控（香港）参与经营海外业务，主要包括投资银行、销售及交易、资产管理业务等。投资银行业务方面，公司保荐中国及外国公司于香港联交所进行首次公开发售、股权及债券承销、跨境并购咨询并为客户提供融资方案。销售及交易业务方面，公司提供证券交易及做市服务以及固定收益类、信用、期货合约及结构产品，并为客户提供度身定制的产品，也向零售及机构客户提供全球证券、期货经纪服务及融资服务。资产管理业务方面，公司向机构客户、高净值及零售客户提供组合及基金管理服务，也利用香港离岸人民币中心的领先地位开发各类人民币资产管理产品。

海外业务主要业绩驱动因素包括经纪佣金、承销保荐费、顾问费、利息收入及资产管理费等。2016 年，公司海外业务实现营业收入人民币 22,150.13 万元，同比减少 39.07%；营业成本人民币 57,583.66 万元，同比增长 101.95%；毛利率 -159.97%，同比减少 181.74 个百分点。

除此之外，总部还有一些其他业务，包括公司总部一般运营资本用途产生的利息收入与开支，总部中后台部门的费用支出以及对联营企业的投资收益等。

二、发行人 2016 年度财务情况

发行人 2016 年按照中国企业会计准则编制的财务报告已经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审计，并出具了标准无保留意见的审计报告，主要财务数据如下：

（1）合并资产负债表主要数据

单位：人民币万元

| | 2016 年 12 月 31 日 | 2015 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------|------------------|
| 资产合计 | 40,145,039.76 | 45,261,461.53 |
| 负债合计 | 31,579,020.11 | 37,108,584.46 |
| 归属于母公司股东的权益合计 | 8,435,745.64 | 8,078,492.49 |
| 负债和所有者权益合计 | 40,145,039.76 | 45,261,461.53 |

（2）合并利润表主要数据

单位：人民币万元

| | 2016 年度 | 2015 年度 |
|--------------|--------------|--------------|
| 营业收入 | 1,691,701.94 | 2,626,193.99 |
| 营业成本 | 851,906.86 | 1,199,186.55 |
| 营业利润 | 839,795.08 | 1,427,007.44 |
| 利润总额 | 859,342.80 | 1,426,349.68 |
| 归属于母公司股东的净利润 | 627,061.15 | 1,069,687.09 |
| 净利润 | 651,948.79 | 1,079,790.82 |

(3) 合并现金流量表主要数据

单位：人民币万元

| | 2016 年度 | 2015 年度 |
|---------------|---------------|---------------|
| 经营活动产生的现金流量净额 | -1,535,572.88 | 1,482,039.85 |
| 投资活动产生的现金流量净额 | -446,265.12 | -2,112,233.99 |
| 筹资活动产生的现金流量净额 | -500,966.27 | 5,383,308.82 |
| 现金及现金等价物净增加额 | -2,431,973.59 | 4,795,000.49 |
| 年末现金及现金等价物余额 | 12,622,054.79 | 15,054,028.38 |

(4) 主要财务指标

| | 2016 年度 | 2015 年度 |
|----------------------|---------|---------|
| 基本每股收益（元/股） | 0.88 | 1.65 |
| 稀释每股收益（元/股） | 0.88 | 1.65 |
| 每股经营活动产生的现金流量净额（元/股） | -2.14 | 2.07 |
| 加权平均净资产收益率(%) | 7.73 | 17.09 |
| 资产负债率(%) | 78.66 | 81.99 |
| 营业利润同比增长率(%) | -41.15 | 143.95 |
| 归属母公司股东的净利润同比增长率(%) | -41.38 | 138.44 |

第三章 发行人募集资金使用情况

一、本期债券募集资金情况

2015 年 6 月 26 日，发行人成功发行人民币 180 亿元次级债券。本期发行的募集资金总额已于 2015 年 6 月 26 日汇入发行人指定的银行账户。

二、本期债券募集资金实际使用情况

根据本期债券募集说明书的相关内容，本期债券募集资金中扣除发行等相关费用后，将主要用于补充营运资金。

截至本报告出具日，发行人已将本期债券募集资金按照募集说明书的有关约定全部补充营运资金，资金投向符合募集说明书的要求。

第四章 本期债券利息偿付情况

本期债券的付息日期为 2016 年至 2017 年每年的 6 月 26 日。如遇法定节假日或休息日，则顺延至其后的第 1 个工作日；每次付息款项不另计利息。报告期内，本期债券于 2016 年 6 月 27 日向投资者支付利息。

第五章 债券持有人会议召开情况

2016 年度，发行人未发生须召开债券持有人会议的事项，未召开债券持有人会议。

第六章 债券跟踪评级情况

“15 华泰 04”的信用评级机构为上海新世纪资信评估投资服务有限公司。上海新世纪资信评估投资服务有限公司于 2015 年完成了对本期债券的初次评级。根据《华泰证券股份有限公司 2015 年第三期次级债券信用评级分析报告》，经上海新世纪资信评估投资服务有限公司（以下简称“上海新世纪”）综合评定，发行人的主体信用等级为 AAA，本期债券的信用等级为 AA+。

根据中国证监会相关规定、评级行业惯例以及上海新世纪评级制度相关规定，自首次评级报告出具之日（以评级报告上注明日期为准）起，上海新世纪将在本期债券信用级别有效期内或者本期债券存续期内，持续关注本期债券发行人外部经营环境变化、经营或财务状况变化以及本期债券偿债保障情况等因素，以对本期债券的信用风险进行持续跟踪。跟踪评级包括定期和不定期跟踪评级。

在跟踪评级期限内，上海新世纪将于发行主体年度报告公布后两个月内完成该年度的定期跟踪评级，并发布定期跟踪评级结果及报告；在此期限内，如发行主体发生可能影响本期债券信用级别的重大事件，应及时通知上海新世纪，并提供相关资料，上海新世纪将就该事项进行调研、分析并发布不定期跟踪评级结果。

截至目前，根据中国证券监督管理委员会《上市公司证券发行管理办法》、《公司债券发行与交易管理办法》及上海证券交易所《股票上市规则》、《公司债券上市规则》等相关规定，华泰证券股份有限公司委托信用评级机构上海新世纪资信评估投资服务有限公司对 2015 年 6 月发行的 2 年期次级债券（以下简称“15 华泰 04”）进行了跟踪信用评级。上海新世纪在对发行人经营状况进行综合分析、与评估的基础上，出具了《华泰证券股份有限公司 2015 年次级债券跟踪评级报告》。评级报告维持发行人主体长期信用等级为 AAA 级，15 华泰 04 信用等级为 AA+级，债券评级展望均为稳定。

第七章 负责处理与本期债券相关事务专人的变动情况

2016 年 12 月 21 日，公司第四届董事会第一次会议审议通过了《关于聘任公司董事会秘书等的议案》，根据公司董事长提名，公司董事会同意聘任罗毅为证券事务代表。罗毅先生已于 2017 年 2 月 23 日参加上交所组织的董事会秘书资格培训并取得了董事会秘书资格证书，正式出任公司新的证券事务代表。

目前，公司证券事务代表罗毅先生负责处理与本期债券的相关事务。

第八章 其他事项

一、对外担保情况

华泰金控（香港）公司下设的 Huatai International Finance I Limited 于 2014 年 10 月 8 日完成了首期境外债券发行。为增强本次首期境外债券的偿债保障，降低发行利率，根据公司 2013 年度股东大会的授权，公司获授权人士确定由中国银行澳门分行以开立备用信用证方式为本次首期境外债券提供担保。同时，根据公司第三届董事会第九次会议决议，公司就发行的首期境外债券开立的备用信用证向中国银行出具反担保函，反担保金额不超过本次债券本金、利息及其他相关费用合计 30 亿元人民币等值美元。保证方式为连带责任保证，保证期结束日期为备用信用证有效期届满之日起六个月。

2015 年 1 月，华泰资管公司正式营业。为保证华泰资管公司各项风险控制指标持续符合监管要求，经公司第三届董事会第十六次会议和 2014 年度股东大会审议批准，公司为华泰资管公司提供最高额度为人民币 12 亿元的净资本担保，并承诺当华泰资管公司开展业务需要现金支持时，公司将无条件在上述额度内提供现金。经公司第三届董事会第三十五次会议及 2016 年第二次临时股东大会审议通过，公司为华泰资管公司提供最高额度为人民币 50 亿元的净资本担保，并承诺当华泰资管公司开展业务需要现金支持时，公司将无条件在上述额度内提供现金。

二、重大诉讼、仲裁事项

截至 2016 年 12 月 31 日，华泰证券及控股子公司涉及的有关诉讼与仲裁事项的具体情况如下：

（一）诉讼、仲裁事项已在临时公告披露且无后续进展的

1、华泰联合证券与四通集团、四通集团财务公司债权债务纠纷案：华泰联合证券原股东四通集团公司下属企业四通集团财务公司非法占用华泰联合证券资金引起了三单债权债务纠纷案。其中两案分别由深圳市中级人民法院作出

（2001）深中法经一初第 315 号民事判决书和（2002）深中法经一初第 430 号民事调解书。根据上述判决书和调解书，四通集团应分别偿还华泰联合证券人民币

7,345 万元及其利息和人民币 9,940 万元及利息。上述民事判决书和民事调解书均已生效，两案正在执行中。对于另一案，华泰联合证券于 2008 年 6 月向北京市高级人民法院提起诉讼，请求法院判令四通集团公司向华泰联合证券支付欠款总额人民币 23,775.36 万元人民币、利息人民币 2,187.72 万元，合计标的人民币约 2.60 亿元。本案由北京市高级人民法院于 2009 年 12 月 17 号作出的（2008）高民初字第 1080 号民事判决书结案，对方没有上诉，该一审判决已经生效，该判决确认四通集团应付公司本金人民币 17,553.40 万元及利息。此案正在执行中。

2、华泰联合证券与中国华诚集团财务有限责任公司（以下简称“华诚集团公司”）、华诚投资管理有限公司（以下简称“华诚投资公司”）债权债务纠纷案：因华诚集团公司无偿占用华泰联合证券营业部资金共人民币 3,720 余万元，以及因它与其他债权人的债务纠纷而被各地法院从华泰联合证券三家营业部及华泰联合证券本部扣划现金共人民币 1,738 万元，华诚集团公司拒不履行偿债义务，华泰联合证券于 2003 年 12 月向深圳市中级人民法院提起诉讼，要求华诚投资公司和华诚集团公司承担连带清偿责任。立案后，由于最高人民法院已下文通知各地法院暂停受理、审理、执行对华诚投资公司及所属公司的诉讼案件，该案一直处于中止审理阶段。2009 年 5 月，法院裁定华诚投资公司进入破产清算程序，华泰联合证券于 2009 年 8 月向破产清算组申报债权本息人民币 12,598 万元，但由于债权未经法院判决，债权待确认。2010 年 3 月深圳中级人民法院恢复审理，一审判决结果支持华泰联合证券全部诉讼请求，要求华诚投资公司和华诚集团公司连带支付华泰联合证券人民币 5,458.4 万元，并承担诉讼费人民币 28.2 万元，华泰联合证券已就上述债权和诉讼费向华诚投资公司破产清算组申报破产债权，2012 年 12 月 21 日，华泰联合证券收到了北京市第二中级人民法院（以下简称“二中院”）民事裁定书，裁定终结华诚投资公司破产程序，华诚投资公司破产程序期间华泰联合证券共获得 276.44 万股华纺股份股票及人民币 182.40 万元。2012 年 7 月法院裁定华诚集团公司进入破产清算程序，2013 年 6 月，破产清算管理人发出《关于审查申报债权的函》让华泰联合证券确认债权，2014 年 3 月 21 日，二中院召开华诚财务债权人会议，破产管理人以“由于华泰联合证券有限责任公司否认华诚投资公司的股东身份，因此对贵公司享有的华诚集团公司的债权不予确认。”因此，华泰联合证券向北京市第二中级人民法院提起确认债权诉

讼，二中院于 2014 年 11 月 18 日做出（2014）二中民初字第 6794 号判决，确认了华泰联合证券对华诚集团公司享有债权金额人民币 39,387,194.72 元。双方股权纠纷，由二中院于 2015 年 10 月 26 日出具的（2015）二中民（商）初字第 05326 号民事判决书结案，驳回华诚股权确认诉讼请求。确认原登记在华诚投资公司名下的 252 万股减资注销有效。

3、华泰期货公司客户张晓东期货账户于 2013 年 4 月 16 日发生重大穿仓事件，穿仓金额为人民币 22,639,786.41 元。由于张晓东未能偿还华泰期货代其垫付的穿仓损失款，华泰期货于 2013 年 12 月 27 日向上海市第一中级人民法院对张晓东提起民事诉讼，要求张晓东赔偿华泰期货代其垫付的穿仓损失并承担全部的诉讼费用。上海市第一中级人民法院于 2014 年 5 月 29 日开庭审理，并于 6 月 25 日下达判决书[（2014）沪一中民六（商）初字第 1 号]，依法判决被告张晓东应于本判决生效之日起十日内偿还原告华泰期货人民币 22,639,786.41 元，并支持了华泰期货要求张晓东负担案件受理费的请求。华泰期货于 2014 年 11 月 11 日向上海市第一中级人民法院申请强制执行客户张晓东穿仓欠款，目前该案正在执行过程中。关于该案件申请财产执行的情况，华泰期货于 2015 年 6 月底收到河南省三门峡市中级人民法院执行裁定书：因被执行人暂无履行债务能力，本案未能有效执结，法院终结本次执行程序。华泰期货如发现被执行人有可供执行的财产，可随时向法院申请恢复执行。根据相关财务制度规定，此笔客户穿仓已于 2013 年度计入“应收风险损失款”处理。华泰期货根据期货行业财务管理相关规定计提期货风险准备，此笔客户穿仓不需要再计提坏账准备。

（二）临时公告未披露或有后续进展的诉讼、仲裁情况

1、华泰证券就质权项下存单提起执行异议：华泰证券作为“华泰证券金陵六号定向资产管理计划”（简称：金陵六号计划）管理人，根据委托人投资指令，于 2014 年 4 月 22 日以定向计划资金投资昆山凯虹汽车贸易有限公司（简称：昆山凯虹）持有的存单收益权，并与昆山凯虹约定 2016 年 4 月 21 日由昆山凯虹全额购回该存单。为确保回购条款的正常履行，昆山凯虹将该存单（人民币 2,500 万）质押给华泰证券。因昆山凯虹其他纠纷，其相关资产（包括为该笔业务所质押的 2,500 万存单）被昆山市人民法院冻结。依据相关合同约定，如存单转让人涉及纠纷，金陵六号计划管理人可提前行使质权。2015 年 10 月，华泰证券向昆山市

人民法院提出执行异议，请求法院解冻该企业质押给华泰证券的 2,500 万存单。昆山市人民法院已受理华泰证券执行异议（受理编号：（2016）苏 0583 执异 9 号），该案已于 2016 年 5 月作出裁定，支持华泰证券诉求，相关存单已解除冻结。由于昆山凯虹其他纠纷，苏州市吴江区人民法院轮候冻结该存单。华泰证券已于 2016 年 5 月向苏州市吴江区人民法院提交执行异议。之后因异议被驳回，2016 年 6 月，华泰证券向苏州市吴江区人民法院提起执行异议之诉。苏州市吴江区人民法院已受理华泰证券执行异议之诉（受理编号：（2016）苏 0509 民初 8451 号），该案已于 2016 年 11 月 22 日开庭审理，苏州市吴江区人民法院于 2017 年 1 月 18 日出具判决，支持华泰证券对案涉存单依法享有质权。目前涉及存单已解除冻结。华泰证券为金陵六号计划管理人，接受该计划委托人委托进行诉讼，形成损益归入该计划资产。该计划资产与华泰证券资产相互独立，本次诉讼对公司本期利润或期后利润没有不利影响。

2、华泰联合证券与北京华资银团集团债权债务纠纷案：因北京华资银团集团一直未按协议履行对华泰联合证券的还款义务，华泰联合证券于 2011 年 1 月向深圳市福田区人民法院起诉，要求其返还本金及利息共计人民币 3,457.89 万元，2011 年 2 月，法院一审判决，要求北京华资银团集团支付华泰联合证券欠款人民币 2,430 万元及银行同期存款利息，对方不服该判决，提起上诉，2011 年 6 月深圳市中级人民法院下达终审判决，驳回上诉，维持原判。目前，该案仍在执行过程中。华泰联合证券起诉黄祖祥、黄平、黄祖峰、北京华资银团集团与华泰联合证券有关的纠纷一案，北京市第三中级人民法院于 2015 年 12 月 4 日出具（2015）三中民（商）初字第 03020 号，确定黄祖祥、黄祖峰为华资银团股东代华资银团向华泰联合证券偿付债务本金人民币 2,430 万元、案件受理费人民币 9.10 万元。2016 年至今，黄祖祥、黄祖峰未履行偿还义务，2016 年 5 月 31 日，华泰联合证券向北京市第三中级人民法院申请执行。

3、中国原子能工业有限公司（以下简称“原子能公司”）诉华诚集团公司、华诚投资公司存单纠纷一案，二中院于 1999 年 2 月 10 日作出（1998）二中经初字第 1218 号民事判决。判决生效后，原子能公司于 1999 年 7 月 12 日向二中院申请执行。二中院依法查封了华诚投资公司持有的联合证券有限责任公司（以下简称“联合证券公司”）股权，此后，原子能公司通过拍卖竞买了华诚投资公司持

有的联合证券公司 3,660 万股股权。后因联合证券公司认为华诚投资公司在出资入股联合证券公司之初存在人民币 1,498 万元的不实出资（被法院执行扣划），通过向北京市高级人民法院、最高人民法院申诉、提出执行异议等措施，最后二中院、原子能公司将人民币 1,498 万元对应的联合证券公司股权 1,348 万股股权从原子能公司拍卖所得的联合证券公司 3,660 万股股权中扣除，其余的 2,312 万股股权过户至原子能公司名下，但上述 1,348 万股股权仍以原子能公司的名义申请二中院继续冻结。

2003 年底，联合证券公司向法院起诉华诚集团公司和华诚投资公司，后因最高人民法院以明传电报的形式通知全国各地法院暂停受理所有针对华诚集团公司及其下属公司的案件。在这种背景下，联合证券公司主动与原子能公司协商，就上述仍以原子能公司名义申请二中院冻结的 1,348 万股股权的处置事宜，双方在互利互惠的基础上达成一致，上述 1,348 万股股权联合证券公司同意继续执行到原子能公司名下，但这 1,348 万股股权按照大致四六开的比例，原子能公司拿 550 万股，联合证券公司拿 798 万股以抵偿华诚投资公司对其的债务。2008 年，华诚投资公司 1,348 万股股权过户到原子能公司名下，由此形成原子能公司代联合证券公司持有原华诚投资公司在联合证券公司的股权 798 万股的情况。

2009 年，华泰证券重组联合证券公司，联合证券公司名称变更为华泰联合证券有限责任公司，缩股后原子能公司持有华泰联合证券股权 1,098 万股，其中自持 858.6 万股，代持 239.4 万股。之后华泰证券亦与原子能公司进行协商，最终达成原子能公司代持的 239.4 万股中的 200 万股转让给华泰证券，转让款支付给华泰联合证券。剩余 39.4 万股与原子能公司的 858.6 万股合计 898 万股换成华泰证券股权。但原子能公司代持 200 万股的问题至今没有解决。

2014 年 12 月 23 日，北京市西城区人民法院依法受理华泰联合证券诉原子能公司合同纠纷一案。2016 年 6 月 28 日，北京市西城区人民法院出具（2015）西民（商）初字第 1048 号民事判决书判决华泰联合证券胜诉。法院判决被告继续履行《股权代持协议》、《代持股权挂牌转让协议》，并于判决生效之日起三十日内完成 200 万股股权的挂牌转让事宜，并将股权转让所得价款给付华泰联合证券。该判决已生效，正在执行中。（上表诉讼涉及金额以华泰联合证券报告期末净资产数据估算）

4、华泰证券与四川圣达集团有限公司债权债务纠纷案：2012 年四川圣达集团有限公司公司债券（简称：12 圣达债，债券代码：1280443）未能按期足额向华泰证券付息及兑付回售债券本金。华泰证券根据债券持有人会议决定，与其他债权人共同委托天津银行股份有限公司成都分行于 2016 年 6 月 7 日向四川省高级人民法院提起诉讼，要求四川圣达集团有限公司返还本金和利息，总本金人民币 3 亿元，按照票面利率 7.25% 从 2014 年 12 月 6 日起至付清之日止，并按照年利率 3.625% 支付罚息从 2015 年 12 月 6 日起至付清之日止（其中华泰证券涉及本金人民币 5,000 万元）。截止 2016 年 12 月 31 日，华泰证券应收四川圣达集团有限公司本金人民币 5,000 万元，利息人民币 750.82 万元，罚息人民币 194.16 万元，案件正在审理中。

5、华泰证券华福厦门银行 1 号定向资产管理计划项下票据纠纷：华泰证券华福厦门银行 1 号定向资产管理计划（“华福厦门银行 1 号”）委托人厦门银行股份有限公司于 2016 年 10 月 17 日，就华福厦门银行 1 号项下相关票据纠纷，向福建省高级人民法院提起了以宁波银行股份有限公司深圳分行为被告的合同纠纷诉讼，诉讼金额暂计为人民币 47,384.50 万元（暂计至 2016 年 10 月 17 日）。被告宁波银行股份有限公司深圳分行接获福建省高级人民法院的应诉通知书等诉讼材料后，于 2016 年 11 月 18 日向福建省高级人民法院提交了《管辖权异议申请书》，提出管辖权异议。待本案件管辖权确定后，管辖法院将择期开庭审理。

华泰资管公司作为华福厦门银行 1 号定向资产管理计划管理人，被列为民事诉讼第三人，未被要求承担赔偿责任，本次诉讼对华泰资管公司本期利润或期后利润没有不利影响。

三、相关当事人

截至本报告出具日，本期债券的受托管理人和资信评级机构均未发生变动。

（本页无正文，为中信证券股份有限公司关于《华泰证券股份有限公司 2015 年第三期次级债券债券受托管理人报告（2016 年度）》之盖章页）



债券受托管理人：中信证券股份有限公司

2017 年 6 月 22 日